

Компьютерная арифметика. Погрешности вычислений

Храмов Д. А.

30.12.2019

Содержание

- ▶ Компьютерная арифметика: что не так?
- ▶ Числа с плавающей точкой
- ▶ *Аппроксимация числа*
- ▶ Расстояние между соседними числами
- ▶ Следствия конечности разрядной сетки
- ▶ Машинный эпсилон
- ▶ *ПРК “Пэтриот”, 25.02.1991 — ошибка при перехвате иракских ракет*
- ▶ *Ариан-5, 4.06.1996 — взрыв после 40 секунд полета*
- ▶ Погрешность вычислений
- ▶ Погрешности вычисления суммы и разности
- ▶ *Катастрофическая потеря точности при вычитании близких чисел одного знака*
- ▶ Неустранимые погрешности
- ▶ Погрешности вычислений и округления
- ▶ Резервирование памяти под массив
- ▶ Ускорение за счет памяти
- ▶ Роль оперативной памяти
- ▶ Разбиваем задачу на части
- ▶ “Правильные” типы данных
- ▶ Функции управления памятью
- ▶ Советы по эффективному программированию
- ▶ *Метод половинного деления*

Компьютерная арифметика: что не так?

Значения функции на компьютере отличаются от принятых в математике:

$\cos \pi/2 = 0$, но $\cos(\text{pi}/2) = 6.1232\text{e-}17$.

Результат суммирования зависит от порядка выполнения операций:

```
>> x = 0.1+(0.2+0.3);
```

```
>> y = (0.1+0.2)+0.3;
```

```
>> % x и y равны?
```

```
>> x==y
```

```
ans =
```

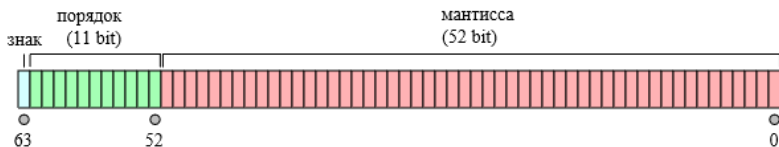
```
0
```

Математический объект \neq Компьютерная реализация

Числа с плавающей точкой

Вещественные числа представляются в памяти компьютера в форме записи с *плавающей точкой*.

Для хранения вещественного числа в памяти компьютера отводится поле стандартной длины — машинное слово длиной 64 бита.

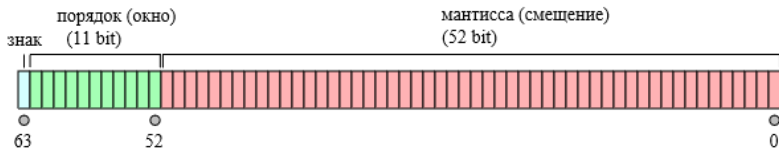


Конечная разрядная сетка для представления чисел на компьютере — источник отличий машинной арифметики от обычной.

Запись числа с плавающей точкой похожа на экспоненциальную запись в математике:

$$1045.86 \Rightarrow 0.104586 \cdot 10^4 \Rightarrow 104586E04$$

До буквы *E* располагается *мантисса*, после — *порядок*.

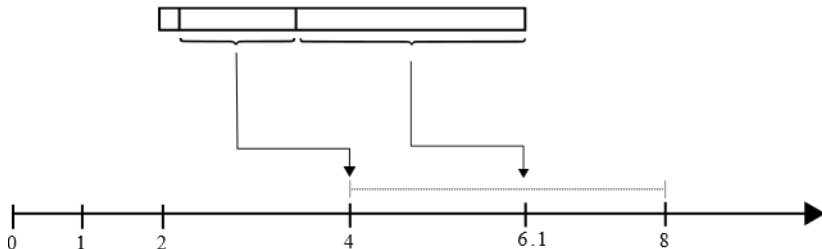


Порядок (окно) сообщает нам, между какими двумя последовательными степенями двойки будет число: $[0, 1]$, $[1, 2]$, $[2, 4]$, $[4, 8]$, \dots , $[2^{2047}, 2^{2048}]$.

Мантисса или смещение разделяет окно на $2^{53} = 9007199254740992$ сегментов.

ПРИМЕР. Аппроксимация числа 6.1

С помощью окна и смещения можно аппроксимировать число.



Значение 6.1 аппроксимируется с помощью числа с плавающей точкой

Расстояние между соседними числами

В окне $[0, 1]$ 9007199254740992 смещений накладываются на интервал размером 1, что дает нам точность

$$\frac{(1 - 0)}{9007199254740992} = 1.1102230246251565404236316680908e^{-16}.$$

В окне $[2^{12}, 2^{13}]$ смещения накладываются на интервал размером $8192 - 4096 = 4096$, что дает нам точность

$$\frac{(8192 - 4096)}{9007199254740992} = 4,5474735088646411895751953125e^{-13}.$$

В окне $[2^{127}, 2^{128}]$ смещения накладываются на интервал $2^{128} - 2^{127} \approx 1,7014e^{+38}$, что дает точность

$$\frac{(2^{128} - 2^{127})}{9007199254740992} = 18889465931478580854784.$$

Следствие 1. В компьютере представимо конечное подмножество рациональных чисел

В компьютере представимы не все числа, а лишь конечное подмножество рациональных чисел, “укладывающихся” в рамки машинного слова. Любое другое число будет представлено с ошибкой округления, не меньшей единицы самого младшего разряда мантиссы.

Машинным эпсилоном (машинной точностью, `eps`) называется наименьшее представимое в компьютере число ε , удовлетворяющее условию $1 + \varepsilon > 1$.

Машинный эпсилон характеризует наименьшую относительную погрешность вычислений и зависит от архитектуры компьютера и разрядности вычислений (`single`, `double`, ...).

```
eps = 1; x = 1;  
while x + eps > x, eps = eps/2, end
```

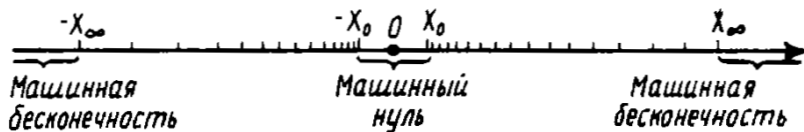

Следствие 2. Диапазон изменения чисел в компьютере ограничен

Существует минимальное X_0 (realmin) и максимальное X_∞ (realmax) числа, которые можно представить на данном компьютере.

```
>> realmin
ans =
    2.225073858507201e-308
>> realmax
ans =
    1.797693134862316e+308
```

- ▶ Числа, меньшие по модулю X_0 для машины не различимы и представляют собой **машинный нуль** ($X_0 \ll \varepsilon$).
- ▶ Числа, большие X_∞ рассматриваются как машинная **бесконечность** (Inf).
- ▶ Диапазон представления чисел на компьютере определяется разрядностью порядка.

Следствие 3. Числа на “компьютерной” числовой прямой распределены неравномерно



Плотность чисел с плавающей точкой возрастает по мере приближения к нулю и убывает по мере отдаления

Резюме по машинной арифметике

В машинной арифметике нарушаются правила обычной арифметики из-за конечности разрядной сетки компьютера.

Почти наверняка в представимом на компьютере множестве числе нет числа y , являющегося решением поставленной задачи.

Лучшее, что можно попытаться сделать, — это найти его представление $y^* = fl(y)$ с относительной точностью порядка ε .

Пока непонятно, чем это все нам грозит.

ПРК “Пэтриот”, 25.02.1991 — ошибка при перехвате иракских ракет

Время измерялось системными часами в десятках секунд, а затем умножалось на $1/10$ чтобы получить результат в секундах.

Вычисление производились с 24-разрядными числами.

$1/10$ — бесконечная двоичная дробь, которая обрезалась после 24-го разряда. Появлялась ошибка округления, из-за которой батарея противоракет, находившаяся на боевом дежурстве около 100 часов, накапливала погрешность в определении времени в 0.34 с.

Ракета “Scud” (P-17) летит со скоростью около 1676 м/с и за 0.34 с. пролетает около 0.5 километра. В итоге система ПРО не реагировала на подлетающую ракету, считая что та находится за пределами охраняемого участка.

Источник: <http://www-users.math.umn.edu/~arnold/disasters/patriot.html>

Проверим?

Что будет, если сравнить

$0.3 == 0.3$

А это?

$0.4 - 0.1 == 0.3$

Что подлетало: Р-17



Куда прилетело



Ариан-5, 4.06.1996 — взрыв после 40 секунд полета

The rocket was on its first voyage, after a decade of development costing \$7 billion. The destroyed rocket and its cargo were valued at \$500 million. The cause of the failure was a software error in the inertial reference system. Specifically a 64 bit floating point number relating to the horizontal velocity of the rocket with respect to the platform was converted to a 16 bit signed integer. The number was larger than 32768, the largest integer storeable in a 16 bit signed integer, and thus the conversion failed.

Источник: <http://www-users.math.umn.edu/~arnold/disasters/ariane.html>

Boeing CST-100 Starliner, 20.12.2019 — никогда такого не было, и вот опять

После того, как CST-100 успешно отделился от ракеты-носителя, произошёл непредвиденный сбой в системе расчёта полётного времени корабля. В результате было израсходовано много топлива, нужного для планировавшейся на следующий день стыковки с МКС. В итоге, было принято решение отменить стыковку корабля с МКС и попытаться вывести корабль Starliner на орбиту, которая позволила ему вернуться на Землю в течение 48 часов.

Источник: https://ru.wikipedia.org/wiki/CST-100_Starliner

Погрешность вычислений

- ▶ a — точное значение, вообще говоря, неизвестное;
- ▶ a^* — известное приближенное значение.

Абсолютная погрешность (absolute tolerance)

$$\Delta(a^*) = |a - a^*|.$$

Чтобы охарактеризовать точность, абсолютной погрешности недостаточно. Погрешность нужно сопоставлять со значением измеряемой величины.

Относительная погрешность (relative tolerance)

$$\delta(a^*) = \frac{|a - a^*|}{|a|}.$$

Относительная погрешность не зависит от масштабов и единиц измерения. Ее удобно определять в процентах.

На практике точное значение числа неизвестно и вместо самих погрешностей оперируют их оценками.

Погрешность вычисления суммы

Абсолютная погрешность вычисления $a + b$:

$$\Delta(a^* + b^*) = |(a - a^*) + (b - b^*)| \leq |a - a^*| + |b - b^*| = \Delta(a^*) + \Delta(b^*)$$

$$\Delta(a^* + b^*) \leq \Delta(a^*) + \Delta(b^*)$$

Относительная погрешность:

$$|a + b| \delta(a^* + b^*) = \Delta(a^* + b^*) \leq \Delta(a^*) + \Delta(b^*) = |a| \delta(a^*) + |b| \delta(b^*) \leq$$

$$\leq (|a| + |b|) \delta_{max} = |a + b| \delta_{max}$$

$$\delta(a^* + b^*) \leq \delta_{max}$$

Погрешность вычисления разности

Абсолютная погрешность вычисления $a - b$:

$$\Delta(a^* - b^*) = |(a - a^*) - (b - b^*)| \leq |a - a^*| + |b - b^*| = \Delta(a^*) + \Delta(b^*)$$

Относительная погрешность $a - b$ при условии, что a и b одного знака:

$$|a - b| \delta(a^* - b^*) \leq |a| \delta(a^*) + |b| \delta(b^*) \leq (|a| + |b|) \delta_{max} = |a + b| \delta_{max}$$

$$\delta(a^* - b^*) \leq \frac{|a + b|}{|a - b|} \delta_{max}$$

При $a \approx b$: $\delta(a^* - b^*) \rightarrow \infty$.

ПРИМЕР. Катастрофическая потеря точности при вычитании близких чисел одного знака

$$\delta(a^* - b^*) \leq \frac{\Delta(a^* + b^*)}{|a - b|}$$

$a^* = 47.132 \pm 0.0005$ и $b^* = 47.111 \pm 0.0005$. Вычислим $\delta(a^* - b^*)$.

1. $\Delta(a^* + b^*) = 0.0005 + 0.0005 = 0.001$
2. $a - b = 0.021$
3. $\delta(a^* - b^*) = 0.001/0.021 \approx 0.05$

$\delta(a^* - b^*)$ в **5000 раз больше** относительных погрешностей исходных данных ($\delta(a^*) = 0.0005/47.132 \approx 0.00001$, $\delta(b^*) \approx 0.00001$).

Следует избегать вычитания близких чисел. Если это невозможно, нужно использовать для вычитаемых чисел типы данных с большей точностью.

Неустранимые погрешности

Погрешности появляются на каждом этапе работы

1. Математическая модель — всегда идеализированное, приближенное описание задачи. Неучтенные в ней факторы являются источником неточностей.

2. Исходные данные получены либо помощью измерений, либо с помощью других моделей. И те, и другие содержат погрешности.

Погрешности модели и исходных данных характерны для любых расчетов. Это **неустранимые погрешности**, поскольку их нельзя убрать или уменьшить в ходе вычислений.

Погрешности вычислений и округления

3. Решением задачи является **вычислительный алгоритм**. Он дает приближенное решение задачи и обладает погрешностями, называемыми погрешности метода.

4. **Погрешности округления** связаны с представлением чисел на компьютере. Например, на компьютере нельзя представить иррациональное число. Разница между округленным числом и исходным и есть погрешность округления.

Резюме по погрешностям

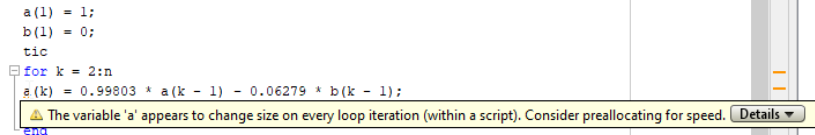
- ▶ Основы точности расчетов закладываются на этапе выбора математической модели. Исходя из этого, выбираются численные методы и программные средства.
- ▶ Во время вычислений нужно не испортить точность, заложенную в модели и исходных данных.
- ▶ Цель вычислений состоит в том, чтобы получить результат с заданной точностью.

Резервирование памяти под размещение массива

... в разы сокращает время вычислений.

Динамический массив заменяется статическим, а это всегда работает быстрее.

```
a(1) = 1;  
b(1) = 0;  
tic  
for k = 2:n  
    a(k) = 0.99803 * a(k - 1) - 0.06279 * b(k - 1);  
end
```



Редактор MATLAB подсказывает, как организовать эффективные вычисления

`checkcode(filename)` (раньше: `mlint(filename)`) — функция, выдающая советы по оптимизации скрипта `filename.m`

Без резервирования

```
n = 1000000;  
a(1) = 1;  
b(1) = 0;  
tic  
for k = 2:n  
    a(k) = 0.99803 * a(k - 1) - 0.06279 * b(k - 1);  
    b(k) = 0.06279 * a(k - 1) + 0.99803 * b(k - 1);  
end  
elapsed_time = toc  
  
elapsed_time =  
  
    0.2667
```

С резервированием

```
n = 1000000;  
a = zeros(1,n); % Preallocation  
b = zeros(1,n);  
a(1) = 1;  
b(1) = 0;  
tic  
for k = 2:n  
    a(k) = 0.99803 * a(k - 1) - 0.06279 * b(k - 1);  
    b(k) = 0.06279 * a(k - 1) + 0.99803 * b(k - 1);  
end  
elapsed_time = toc  
  
elapsed_time =  
  
0.0280
```

Ускорение за счет памяти

Векторизация циклов существенно увеличивает производительность MATLAB-программ. Но происходит это за счет более интенсивного использования памяти.

Одновременное достижение максимума быстродействия и минимума используемой памяти невозможно, так как эти цели противоречат друг другу.

Так, функция `plot` работает со всем массивом сразу. Если массив большой, то будет заметная пауза при выводе графика. Но если строить график по мере расчета новых точек, то в памяти достаточно хранить координаты всего двух точек — “новой” и “старой”.

Роль оперативной памяти

Что такое “большой массив”? Пусть 1 кадр видео представляет собой массив из 10^6 пикселей (точек изображения). Каждый пиксель характеризуется тремя числами (цветами), а каждое число занимает в памяти 8 байт (double или uint64). На хранение кадра выделяется около: $10^6 \times 3 \times 8 = 24$ Мб.

На хранение 25 кадров в секунду потребуется $25 \times 24 = 600$ Мб. Объем оперативной памяти 32 Гб хватит для хранения около 50 секунд видео. Затем появится сообщение об ошибке “Out of Memory” — MATLAB запрашивает памяти больше, чем может получить.

Если для работы памяти нужно больше, чем имеется оперативной памяти, то выделяется место в файле подкачки на диске. Скорость операций, выполняемых на жестком диске в 1000 раз ниже, чем в оперативной памяти. В погоне за скоростью мы откусили слишком большой кусок и не можем его проглотить...

Разбиваем задачу на части

Векторизация операций с маленькими (относительно оперативной памяти) массивами ускоряет работу, а с большими – замедляет ее из-за использования HDD.

Поэтому нужно контролировать объем используемой памяти (*Workspace*), чтобы ресурсы, занимаемые программой, умещались в оперативной памяти. Большой массив можно разбивать части и векторизовать операции с этими частями (тайлинг).

Допустим, мы работаем с массивом, в 4 раза превышающим объем оперативной памяти. Пусть время на обработку части массива, поместившейся в оперативной памяти, равно t . Тогда для оставшихся частей оно составит $3000t$. Если разбить этот массив на четыре меньших, то время на обработку составит всего $4t$.

“Правильные” типы данных

Тип переменной должен соответствовать типу данных, которые в ней находятся, а не браться “с запасом”:

- ▶ `int8` — 8-битное целое число $[-255; 255]$. Еще есть: `int16`, `int32`, `int64`.
- ▶ `uint8` — 8-битное целое число без знака $[0; 255]$. Еще есть: `uint16`, `uint32`, `uint64`.

Функции для преобразования типов данных, как правило, имеют те же имена, что и сами типы.

Функции управления памятью

- ▶ `clear all/имя` — удаление переменных из оперативной памяти (`clear all` очищает много чего);
- ▶ `pack` — “уборка мусора” — MATLAB записывает переменные во временный файл в текущем каталоге (по умолчанию в `pack.tmp`), очищает память, и вновь загружает их, так что становится доступной непрерывная область памяти: пакуются фрагментированные переменные, а возвращаются назад непрерывные;
- ▶ когда и это не помогает: сохраняем переменные на диск (`save — matlab.mat`), перезапускаем MATLAB и загружаем переменные снова с помощью `load`.
- ▶ запуск MATLAB без Java Virtual Machine: `matlab -nojvm`. Для версии 6.1 MATLAB занимает 40 Мб с JVM и 22 без нее. Для версии 7.2 уже 86 Мб с JVM и все те же 22 без.

Советы по эффективному программированию

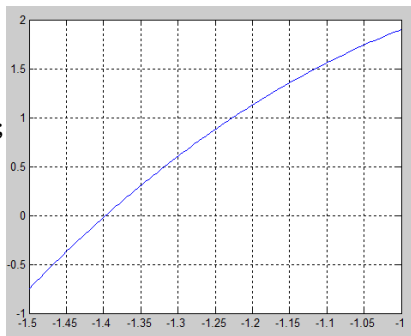
Лозунг Matlab: “Думай векторно” (“Think Vectorized”).
Векторизованные операции обычно работают быстрее, их использование — хороший стиль программирования. Но:

- ▶ Принцип KISS: пишете как вам проще — чтобы работало. Когда заработает (правильно) будете думать об улучшениях.
- ▶ Оцените, стоит ли выгода от переработки кода потраченных на это усилий.
- ▶ Предварительное выделение памяти под большие массивы ускорят работу программы.
- ▶ Следите за использованием оперативной памяти.
- ▶ Скорость работы микросхем оперативной памяти существенно выше скорости работы жесткого диска. Поэтому контролируйте объем используемой памяти и старайтесь, чтобы все ресурсы, используемые программой, умещались в оперативной памяти.

БОНУС. Поиск корней уравнения методом деления пополам

$$x^3 - 1.1x^2 - 2.2x + 1.8 = 0.$$

```
% Уравнение
f = @(x) x.^3-1.1*x.^2-2.2*x+1.8;
% Левая и правая границы
% интервала поиска корня
a = -1.5; b = -1;
% Требуемая точность
delta = 1e-4;
```



Точность здесь — это абсолютная погрешность. Но как ее подсчитать, если значение корня неизвестно? Варианты:

1. сокращая область возможного расположения корня до заданного размера (оценка сверху);
2. по сокращению темпов прироста точности.

Алгоритм (Амосов и др., 1994)

```
ya = f(a); yb = f(b);
```

```
while b-a >= delta
```

```
    c = (a+b)/2;
```

```
    yc = f(c);
```

```
    if yc == 0
```

```
        a = c;
```

```
        b = c;
```

```
    elseif yb*yc>0
```

```
        b = c;
```

```
        yb = yc;
```

```
    else
```

```
        a = c;
```

```
        ya = yc;
```

```
    end
```

```
end
```

```
% корень  
root = (a+b)/2  
% ошибка определения корня  
error = abs(b-a)
```

```
root =
```

```
-1.3971
```

```
error =
```

```
6.1035e-05
```

Поиск корня уравнения: fzero

```
f = @(x) x.^3-1.1*x.^2-2.2*x+1.8;  
root = fzero(f, [-1.5 -1])
```

```
root =
```

```
-1.3970
```

Ссылки

1. Амосов А.А, Дубянский Ю.А., Копченова Н.В.
Вычислительные методы для инженеров. — М.: Высшая школа, 1994. — п. 2.5 “Особенности машинной арифметики”, иллюстрация неравномерного распределения чисел на машинной прямой.
2. Наглядное объяснение чисел с плавающей запятой — иллюстрации, дополняющие объяснение чисел с плавающей запятой из книги Амосова и др.
3. Floating point addition is not associative — простой пример не-ассоциативности сложения чисел на компьютере.
4. Double-precision_floating-point_format — исходная иллюстрация 64-битного представления чисел.
5. *Pascal Getreuer*. Writing Fast MATLAB Code.
6. *Altman Yair M*. Accelerating MATLAB Performance: 1001 Tips to Speed Up MATLAB Programs. CRC Press, Taylor & Francis Group, 2015. — 735 p.